



OROC | Ação de formação Nº 64/23

Assunto: **Ação de Formação Online: Avaliação e Gestão de Risco de Instrumentos de Dívida**

Lisboa, 26 de maio de 2023

Caros Colegas,

Informamos que nos próximos dias 29 e 30 de junho pelas 9h30, a OROC irá realizar uma ação de formação online sob o tema “Avaliação e Gestão de Risco de Instrumentos de Dívida”.

Para melhor divulgação desta ação de formação, remetemos em anexo o respetivo programa.

A inscrição deverá ser efetuada no site da Ordem através do [link](#).

Com os melhores cumprimentos,

**Célia Custódio**

Vogal do Conselho Diretivo

Sede

Rua do Salitre, nº 51/53 | 1250-198 Lisboa  
Telefone(+351) 213 536 158 | Fax(+351) 213 536 149  
[geral@oroc.pt](mailto:geral@oroc.pt)

Serviços Regionais do Norte

Av. da Boavista, nº 3477/3521 2º andar | 4100-139 Porto

[www.oroc.pt](http://www.oroc.pt)

## AVALIAÇÃO E GESTÃO DE RISCO DE INSTRUMENTOS DE DÍVIDA

FORMAÇÃO  
ONLINE

29 e 30/06/2023

Horário: 09h 30 – 13h00

## Formador: Pedro Barreirão

Supervisor bancário no Banco de Portugal e professor adjunto convidado no ISCAL. Doutoramento em Finanças pelo ISCTE-IUL, Pós-Graduado em Regulação Bancária pela NOVA SBE, Pós-Graduado em Contabilidade e Fiscalidade pelo ISCTE-IUL, Mestre em Finanças e Licenciado em Gestão pelo ISEG. Adicionalmente, concluiu as certificações CFA, FRM e CIPM. Tem um percurso profissional nas áreas de controlo de gestão, auditoria externa, recuperação de crédito e supervisão bancária.

## OBJETIVOS

Desenvolver competências que permitam compreender a metodologia de avaliação de instrumentos de dívida, assim, como o processo de gestão dos principais fatores de risco do investimento em instrumentos de dívida.

## RAZÕES PARA PARTICIPAR

A avaliação dos instrumentos de dívida é importante para as decisões de investimento e para a sua contabilização. Desta forma, o conhecimento de metodologias de avaliação deste tipo de instrumentos torna-se fundamental para contabilistas, auditores e investidores. Por sua vez, os instrumentos de dívida têm riscos que podem resultar de perdas financeiras. Neste sentido, torna-se essencial conhecer os riscos a que os instrumentos de dívida estão expostos, para que a exposição ao risco possa ser gerida. Este curso foca as principais metodologias de avaliação e de gestão de risco de instrumentos de dívida.

## PROGRAMA

1. Obrigações de taxa fixa e variável;
2. *Yield do maturity*;
3. Obrigações com opções e obrigações convertíveis;
4. Notações e risco de crédito;
5. Exposição dado ao incumprimento;
6. Probabilidade do incumprimento;
7. Perda dado o incumprimento;
8. *Crédit Value at Risk*.

## DESTINATÁRIOS

Revisores Oficiais de Contas e seus colaboradores, consultores financeiros e outros técnicos e profissionais da área financeira

## PREÇO

ROC e Colaboradores: 84€  
Outros Profissionais: 100€